

Datos fundamentales para el inversor

El presente documento proporciona datos fundamentales para los inversores de este subfondo. No se trata de material de promoción comercial. La ley exige que se facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del subfondo y los riesgos que comporta invertir en él. Es aconsejable que lea el documento para poder tomar una decisión fundada sobre la conveniencia o no de invertir en él.

EQUITY US PREMIUM INCOME, un subfondo de la SICAV THEAM QUANT-

Clase «I - EUR EUR Capitalisation» - Código ISIN LU1480597647

Este Subfondo está gestionado por BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, sociedad del Grupo BNP Paribas.

Objetivos y política de inversión

El objetivo del Subfondo es proporcionar un crecimiento de la renta y del capital mediante la aplicación de una estrategia de opciones sistemática en una selección de acciones estadounidenses cuyo objetivo es generar renta en mercados alcistas y moderadamente bajistas. El Subfondo tiene como objetivo una renta del 5% anual, no se garantiza el logro de este objetivo.

Para alcanzar su objetivo de inversión, el Subfondo implementa una estrategia de inversión cuantitativa (la Estrategia) que consiste en vender opciones de venta a corto plazo sobre una selección de acciones estadounidenses a través del BNP Paribas Stock put Write US Index (el Índice de Estrategia).

El modelo utilizado para crear el índice de estrategia tiene como objetivo:

- Selección mensual de las acciones (reequilibrio) siguiendo un proceso basado en criterios fundamentales y de mercado. El objetivo es examinar el universo de la inversión para identificar las acciones que se benefician de un modelo de negocio sostenible, un impulso favorable de los precios, una alta capitalización media del mercado, una baja correlación con las acciones estadounidenses, una valoración atractiva de la prima de opción y unas condiciones comerciales favorables en el mercado de opciones. El universo de inversión del Índice de Estrategia está compuesto por las mayores capitalizaciones de los mercados de valores de Estados Unidos que ofrecen condiciones de liquidez satisfactorias.

- vender dinámicamente, en proporciones iguales, opciones de la oferta a corto plazo del dinero en cada una de las acciones seleccionadas a través del proceso antes mencionado («estrategia de la puesta-escritura»). Las estrategias put Write apuntan a generating income, limitando al mismo tiempo su volatilidad general, y serán particularmente apropiadas en mercados alcistas y moderadamente bajistas.

El Índice de Estrategia es un índice diversificado basado en un algoritmo cuantitativo desarrollado por BNP Paribas. El desglose completo del Índice Estratégico está disponible en el sitio web: <https://indices-globalmarkets.bnpparibas.com>. El método de cálculo del índice está disponible directamente en: <https://indices-globalmarkets.bnpparibas.com/nr/SPUSTR.pdf>

Los inversores deben tener en cuenta que hay costos anuales de replicación vinculados a la venta dinámica de opciones put a corto plazo, así como costos adicionales resultantes de la gestión de la cartera de estrategias put Write en cada día de reequilibrio. Estos costos reducirán el rendimiento del Índice Estratégico e indirectamente el del Subfondo.

La estrategia del Subfondo se considera activa. El Subfondo no tiene ningún índice de referencia para la comparación de resultados.

Para aplicar la Estrategia, el Subfondo utiliza una Política de Replicación Sintética mediante la celebración de derivados OTC.

La Política de Replicación Sintética implica que el Subfondo invierte sus activos en Valores Mobiliarios o en Instrumentos del Mercado Monetario (los Activos de Financiación) y intercambia la rentabilidad de hasta el 100% de los Activos de Financiación a través de derivados OTC para obtener exposición a la Estrategia. Como parte de la política de replicación sintética, el Subfondo invierte en todo momento al menos el 51% de su patrimonio neto en acciones y/o valores tratados como equivalentes a acciones emitidas por empresas de cualquier país.

Los inversores pueden suscribirse o canjear cualquier día en que la bolsa de Nueva York esté abierta durante todo el día (excepto los sábados y domingos y los feriados públicos de Luxemburgo y Francia).

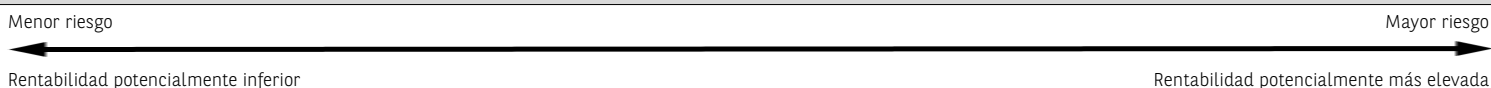
Las solicitudes de suscripción y canje se pueden realizar al agente administrativo antes de las 12,00 h (CET) a más tardar el día de valoración correspondiente.

Agente administrativo: BNP Paribas Securities Services, sucursal de Luxemburgo, 60 avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo.

Los ingresos se reinvierten sistemáticamente.

Los valores liquidativos están sujetos al riesgo de variación entre la divisa de referencia de clase de acción y la moneda de la estrategia.

Perfil de riesgo y de rentabilidad



1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

- La rentabilidad histórica (como la información utilizada para calcular el indicador sintético) no es una indicación fiable del perfil de riesgo futuro del subfondo.
- No se garantiza la categoría de riesgo asociada a este subfondo, que puede cambiar con el tiempo.

- La categoría más baja no significa «libre de riesgo».

La categoría de riesgo se justifica por la rentabilidad del Índice de la Estrategia, que puede subir o bajar significativamente, lo que implica posibles cambios rápidos y drásticos en el valor de la inversión.

Otros riesgos que revisten una importancia significativa para el Fondo y que el indicador no capta de manera adecuada:

- **Riesgo de contraparte:** Este riesgo está relacionado con la capacidad de una contraparte de cumplir sus compromisos (como son el pago, la entrega y el reembolso) en una operación financiera extrabursátil.
- **Riesgo vinculado a la utilización de instrumentos financieros a plazo:** Utilizamos instrumentos financieros a plazo negociados fuera de la bolsa para poder replicar la rentabilidad de la estrategia. Estos instrumentos pueden implicar un conjunto de riesgos que pueden conducir a ajustes o a la propia rescisión del instrumento, lo que puede influir sobre el valor liquidativo.
- **Riesgo de liquidez:** Este riesgo surge de la dificultad de vender un activo a un precio razonable de mercado y en el momento deseado, debido a la falta de compradores.



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

The sustainable investor for a changing world

Gastos

Las comisiones y los gastos sufragados se utilizan para cubrir los costes de funcionamiento del subfondo, incluidos los costes de comercialización y distribución de acciones. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de las inversiones.

Gastos extraordinarios antes o después de la inversión	
Gastos de entrada	Nada
Gastos de salida	Nada
Gastos detraídos del OICVM a lo largo de un año	
Gastos corrientes	0,76% (*)
Gastos detraídos del OICVM en determinadas condiciones específicas	
Comisiones de rentabilidad	Nada

Los gastos de entrada y de salida mostrados son las cifras máximas. En algunos casos usted pagará menos. Puede obtener más información a través de su asesor financiero. (*) La cifra de **gastos corrientes** se basa en los gastos correspondientes pasados determinados el 31 diciembre 2021.

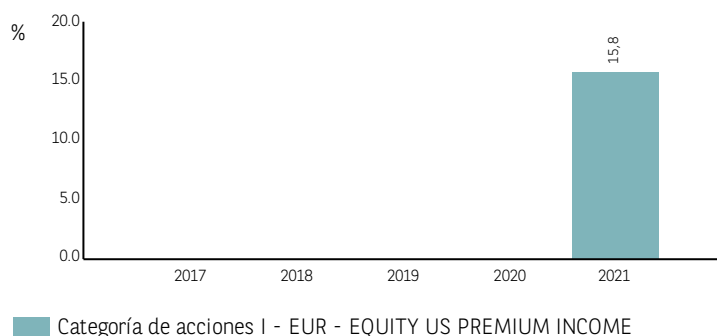
Dicha cifra puede variar de un año a otro. No incluye:

- Comisiones de rentabilidad.
- Los costes de intermediación, exceptuados los gastos de entrada y salida pagados por el subfondo al comprar o vender participaciones de otro organismo de inversión colectiva.

En caso de canje, se puede cobrar a los inversores una comisión máxima del 1.5%.

Si desea más información sobre los gastos, consulte el apartado «Comisiones y gastos» del folleto informativo de la SICAV, que está disponible en la siguiente dirección: <http://www.bnpparibas-am.com>.

Rentabilidad histórica



- La rentabilidad histórica no constituye un indicador de la rentabilidad futura.
- La rentabilidad se calculará neta de gastos de gestión.
- La categoría de acción se lanzó el 19 mayo 2020.
- La rentabilidad histórica se ha calculado en EUR.

Información útil

- Depositario: BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES-LUXEMBOURG BRANCH.
- El presente documento de datos fundamentales para el inversor proporciona información sobre un subfondo de THEAM QUANT- SICAV. El folleto informativo y los informes periódicos son de aplicación a la totalidad de la SICAV que se menciona en la cabecera del documento.
- Los detalles acerca de la política de remuneración actualizada están disponibles en línea en <https://www.bnpparibas-am.com/en/footer/remuneration-policy> o previa solicitud por escrito a la sociedad gestora.
- Los inversores pueden hacer cambios entre los Fondos de THEAM QUANT-. Si desea más información, consulte el folleto informativo o póngase en contacto con su asesor financiero.
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto informativo de la SICAV.
- Los documentos de datos fundamentales para el inversor del subfondo, el folleto informativo y los últimos informes anuales y provisionales se enviarán a los participantes en un plazo de ocho días hábiles tras la recepción de una solicitud por escrito a: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 París Cedex 09.
- El precio de las acciones de la SICAV está disponible en línea en <http://www.bnpparibas-am.com>.
- Para obtener información sobre otras acciones del subfondo, consulte su folleto informativo.
- Dependiendo de su régimen fiscal, las plusvalías y los ingresos asociados a la tenencia de acciones en este subfondo pueden estar sujetos a tributación. Le recomendamos que consulte a su asesor fiscal para obtener más información al respecto.

Este Subfondo está autorizado en el Gran Ducado de Luxemburgo y regulado por la «Commission de Surveillance du Secteur Financier». Los presentes datos fundamentales para el inversor son exactos a 18 febrero 2022.



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

The sustainable investor for a changing world